

## レバレッジ比率の構成に関する事項

みずほ信託銀行【単体】  
2024年6月末

(単位：百万円、%)

| 項番(国際<br>様式(LR1)<br>の該当番<br>号) | 項目   | 2024年6月末  | 2024年3月末  |
|--------------------------------|--|-----------|-----------|
| 1                              | 貸借対照表における総資産の額                               | 4,940,313 | 4,940,223 |
| 3                              | リスク移転の認識に係る要件を充足しない証券化エクスポージャーに係る調整          | -         | -         |
| 4                              | 中央銀行預け金に係る除外による調整(△)                         | 1,102,669 | 1,133,176 |
| 5                              | 顧客資産のうち、貸借対照表に計上されている金額(△)                   | -         | -         |
| 6                              | 有価証券の売買を約定日基準により会計処理している場合における調整項目           | -         | -         |
| 7                              | キャッシュ・プーリング契約に基づく資金の移動に係る調整項目                | -         | -         |
| 8                              | デリバティブ取引等に関する調整額                             | △ 28,848  | △ 20,729  |
| 8a                             | デリバティブ取引等に関する額                               | 6,233     | 5,480     |
| 8b                             | デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)                        | 35,082    | 26,209    |
| 9                              | レボ取引等に関する調整額                                 | 20,066    | 20,066    |
| 9a                             | レボ取引等に関する額                                   | 170,116   | 40,133    |
| 9b                             | レボ取引等に関する額(△)                                | 150,049   | 20,066    |
| 10                             | オフ・バランス取引に関する額                               | 225,076   | 229,427   |
| 11                             | Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)                   | 5,167     | 4,136     |
| 12                             | その他の調整項目                                     | △ 84,225  | △ 82,077  |
| 12a                            | Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)                 | 70,184    | 67,935    |
| 12b                            | 支払承諾見返勘定の額(△)                                | 14,040    | 14,142    |
| 12c                            | デリバティブ取引等に関連して差し入れた担保の対価の額(相殺した額に相当する部分に限る。) | -         | -         |
| 12d                            | デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額(△)          | -         | -         |
| 13                             | 総エクスポージャーの額                                  | 3,964,545 | 3,949,597 |

みずほ信託銀行【単体】  
2024年6月末

(単位：百万円、%)

| 項番(国際様式(LR2)の該当番号)                     | 項目   | 2024年6月末  | 2024年3月末  |
|--|--|-----------|-----------|
| <b>オン・バランス資産の額(1)</b>                  |  |           |           |
| 1                                      | 個別項目調整前のオン・バランス資産の額  | 3,638,471 | 3,746,627 |
| 2                                      | デリバティブ取引等に関連して差し入れた担保の対価の額(相殺した額に相当する部分に限る。)                         | -         | -         |
| 3                                      | デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額(Δ)                                  | -         | -         |
| 4                                      | レボ取引等により受領した証券の計上額(Δ)  | -         | -         |
| 5                                      | Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(Δ)   | 5,167     | 4,136     |
| 6                                      | Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(Δ)   | 70,184    | 67,935    |
| 7                                      | オン・バランス資産の額(イ)   | 3,563,118 | 3,674,556 |
| <b>デリバティブ取引等に関する額(2)</b>               |  |           |           |
| 8                                      | デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額   | -         | -         |
| 9                                      | デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額  | 6,233     | 5,480     |
| 10                                     | 間接清算参加者に適格中央清算機関の債務履行を保証していない場合に零とした中央清算機関向けエクスポージャーの額(Δ)            | -         | -         |
| 11                                     | クレジット・デリバティブ等のプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額                            | -         | -         |
| 12                                     | クレジット・デリバティブ等のプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額から控除した額(Δ)                  | -         | -         |
| 13                                     | デリバティブ取引等に関する額(ロ)  | 6,233     | 5,480     |
| <b>レボ取引等に関する額(3)</b>                   |  |           |           |
| 14                                     | レボ取引等に関する資産の額  | 150,049   | 20,066    |
| 15                                     | レボ取引等に関する資産の額から控除した額(Δ)  | -         | -         |
| 16                                     | レボ取引等に関するカウンターパーティ・リスクのエクスポージャーの額                                    | 20,066    | 20,066    |
| 17                                     | 代理取引のエクスポージャーの額  | -         | -         |
| 18                                     | レボ取引等に関する額(ハ)  | 170,116   | 40,133    |
| <b>オフ・バランス取引に関する額(4)</b>               |  |           |           |
| 19                                     | オフ・バランス取引の想定元本の額   | 651,808   | 670,134   |
| 20                                     | オフ・バランス取引に係るエクスポージャーの額への変換調整の額(Δ)                                    | 426,732   | 440,706   |
| 22                                     | オフ・バランス取引に関する額(ニ)  | 225,076   | 229,427   |
| <b>単体レバレッジ比率(5)</b>                    |  |           |           |
| 23                                     | 資本の額(ホ)  | 445,836   | 446,717   |
| 24                                     | 総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ))(ヘ)                                      | 3,964,545 | 3,949,597 |
| 25                                     | 単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))   | 11.24%    | 11.31%    |
| 26                                     | 適用する所要単体レバレッジ比率  | 3.15%     | 3.00%     |
| <b>日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率(6)</b> |  |           |           |
|  | 総エクスポージャーの額(ヘ)   | 3,964,545 | 3,949,597 |
|  | 日本銀行に対する預け金の額  | 1,102,669 | 1,133,176 |
|  | 日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額(ヘ')                                   | 5,067,214 | 5,082,774 |
|  | 日本銀行に対する預け金を算入する場合の単体レバレッジ比率((ホ)/(ヘ'))                               | 8.79%     | 8.78%     |
| <b>平均値の開示(7)</b>                       |  |           |           |
| 28                                     | レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値((ト)+(チ))                                    | 76,953    | 28,381    |
|  | レボ取引等に関する資産の額に係る平均値(ト)   | 76,953    | 28,381    |
|  | レボ取引等に関する資産の額から控除した額に係る平均値(Δ)(チ)                                     | -         | -         |
| 29                                     | レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る四半期末の値((リ)+(ヌ))                                 | 150,049   | 20,066    |
| 14                                     | レボ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値(リ)  | 150,049   | 20,066    |
| 15                                     | レボ取引等に関する資産の額から控除した額に係る四半期末の値(Δ)(ヌ)                                  | -         | -         |
| 30                                     | 総エクスポージャーの額(レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合)(ル)     | 3,891,448 | 3,957,912 |
| 30a                                    | 総エクスポージャーの額(レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合)(ヲ)      | 4,994,117 | 5,091,088 |
| 31                                     | 単体レバレッジ比率(レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合)((ホ)/(ル)) | 11.45%    | 11.28%    |
| 31a                                    | 単体レバレッジ比率(レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合)((ホ)/(ヲ))  | 8.92%     | 8.77%     |